

Allocation du portefeuille

Classes d'actifs	Fortune totale au 31.12.2019		Stratégie actuelle			OPP2	
	Fortune totale		Limites inférieures	Objectif	Limites supérieures	Limite	Article
Liquidités et court terme	19 567 322	1.4%	0.0%	0.0%	3.0%		
Obligations CHF	212 186 676	15.2%	13.0%	16.0%	19.0%		
Obligations gouvernementales en ME (couvertes)	183 467 134	13.2%	11.0%	14.0%	17.0%		
Obligations d'entreprises en ME (couvertes)	93 805 543	6.7%	5.0%	7.0%	9.0%		
Obligations des marchés émergents HC (couvertes)	54 128 109	3.9%	3.0%	4.0%	5.0%		
Valeurs nominales	563 154 784	40.4%	40.0%	41.0%	60.0%		
Actions	389 506 771	27.9%	18.0%	25.0%	32.0%	50.0%	55 let. b)
Suisse	191 886 857	13.8%	9.0%	12.0%	15.0%		
Large Cap	146 091 288	10.5%	7.0%	9.0%	11.0%		
Small & Mid Cap	45 795 569	3.3%	2.0%	3.0%	4.0%		
Monde DM	155 926 774	11.2%	8.0%	10.0%	12.0%		
Large & Mid Cap	140 624 229	10.1%	8.0%	9.0%	10.0%		
Small Cap	15 302 545	1.1%	0.0%	1.0%	2.0%		
Marchés émergents	41 693 140	3.0%	1.0%	3.0%	5.0%		
Placements alternatifs (couverts)	62 001 299	4.4%	2.0%	6.0%	10.0%	15.0%	55 let. d)
SSL (couverts)	38 820 504	2.8%	1.0%	3.0%	5.0%		
Matières premières (couvertes)	23 180 795	1.7%	1.0%	3.0%	5.0%		
Immobilier	380 445 673	27.3%	23.0%	28.0%	33.0%	30.0%	55 let. c)
Suisse	313 821 522	22.5%	18.0%	22.0%	26.0%		
Direct	157 916 982	11.3%					
Indirect	155 904 540	11.2%					
Etranger (couvert)	66 624 151	4.8%	5.0%	6.0%	7.0%		
Valeurs réelles	831 953 743	59.6%		59.0%			
Total	1 395 108 527	100.0%		100.0%			
Total Monnaies étrangères - après couverture	197 619 914	14.2%	9.0%	13.0%	17.0%	30.0%	55 let. e)
Total Monnaies étrangères - avant couverture	657 646 150	47.1%					
Couverture	460 026 236	33.0%					

Performances du portefeuille

2019

Rendements année sous revue	mio de CHF	T1/19	T2/19	T3/19	oct. 19	nov. 19	déc. 19	T4/19	2019
Portefeuille total	1'395.1	5.31%	2.24%	1.47%	0.38%	1.02%	0.33%	1.74%	11.15%

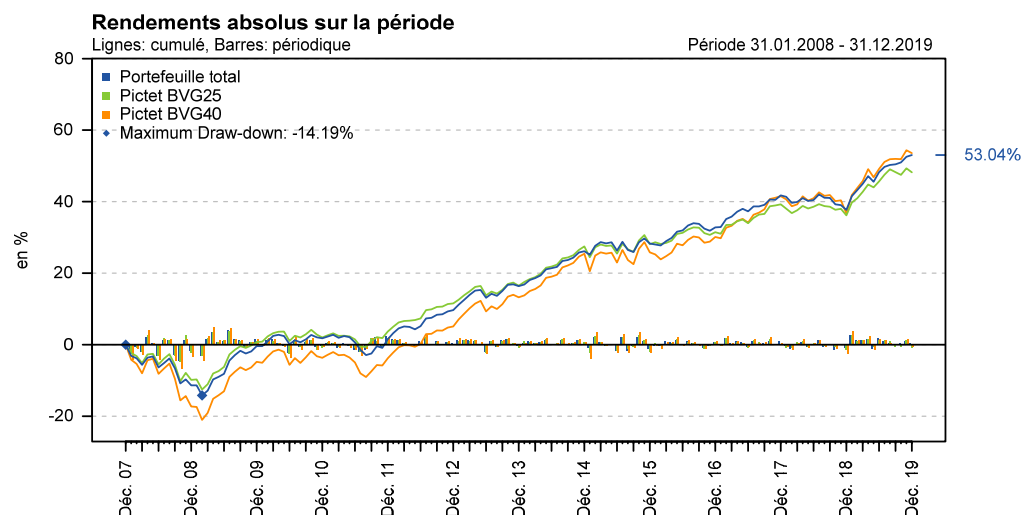
© PPCmetrics SA

Depuis le début de la mesure de performance

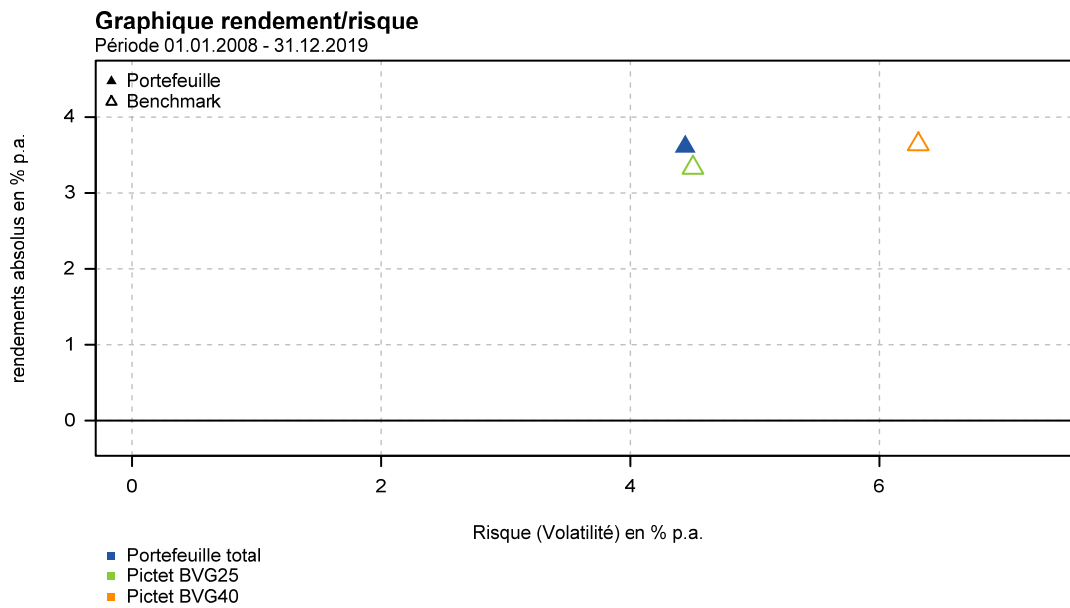
	mio de CHF	2014	2015	2016	2017	2018	2019	Depuis le lancement		
								cumulée	annualisée	Début
Portefeuille total	1'395.1	8.37%	1.71%	3.54%	6.74%	-2.88%	11.15%	53.04%	3.61%	01.01.08

© PPCmetrics SA

Rendements absolus cumulés



Profil rendement / risque du portefeuille



© PPCmetrics SA / Fondation Patrimonia / Konsolidierung/Consolidation / Portefeuille total / 10260

Comparaison à d'autres institutions (du 01.01.2019 au 30.09.2019)

